

Comunicazione del 9 gennaio 2019 - DPM 2.8: istruzioni operative per *Supervisory Benchmarking Portfolios*.

Facciamo seguito alla comunicazione del 27 novembre 2018, con la quale sono state fornite istruzioni operative in merito all'applicazione della versione 2.8 del *Data Point Model* (DPM) dell'EBA.

Forniamo ora specifiche istruzioni per la segnalazione delle basi informative SBPC e SBPI, riguardanti le informazioni sui portafogli di riferimento a fini di vigilanza (*Supervisory Benchmarking Portfolios*).

In particolare:

- gli enti autorizzati a utilizzare i metodi interni per il calcolo dei requisiti in materia di rischio di mercato dovranno inviare i relativi *template* (da C 107 a C 110) con data contabile 31/01/2019, entro il 28 febbraio 2019. In questo flusso informativo i *filing indicator* dei *template* sul rischio di credito devono essere negativi (con attributo *find:filed="false"*) e i relativi dati non devono essere presenti.
- gli enti autorizzati a utilizzare i metodi interni per il calcolo dei requisiti in materia di rischio di credito dovranno inviare i relativi *template* (da C 101 a C 105) con data contabile 31/12/2018, entro l'11 aprile 2019. In questo flusso informativo i *filing indicator* dei *template* sul rischio di mercato devono essere negativi (con attributo *find:filed="false"*) e i relativi dati non devono essere presenti.